

# 套索回归 (Lasso)

---

Lasso 回归可以实现自动化的重要特征值筛选, 从而可以当特征值非常多的时候筛选掉对结果几乎没有影响的特征.

Lasso 回归的目标函数 :

$$\text{MIN}_W F(W) = \lambda |W|_1 + |X^T W - Y|^2$$

相比于Ridge回归大部分类似, Lasso最大的不同就是其是使用的**正规化参数L1**. 这样Lasso 可以达到直接丢弃无关特征的目的(直接系数置为0), 而Ridge只能无限接近于0